

# DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

2020年8月5日(水)

## 短期市場の推移

	7月30日	7月31日	8月3日	8月4日
加重平均金利	▲0.020	▲0.021	▲0.020	▲0.021
東京レポレート(ON)	▲0.082	▲0.073	▲0.065	▲0.067
無コール残	92,669	102,992	88,993	92,615
ON	60,346	72,104	57,385	60,857
その他	32,323	30,888	31,608	31,758
有コール残	18,322	17,254	18,137	19,227

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表  
※加重平均金利は無担保コールONのもの。無 有コール残は無担保・有担保コール残高の意。

## 8月6日の予定 (時刻は日本時間)

日本	予想	海外	予想
		20:00 (英)8月英中銀(BOE)政策金利	0.10%
		21:30 (米)新規失業保険申請件数[前週分]	-

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

## 本日の短期市場金利

	無担保コール(速報)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.060	0.001	▲0.022	▲0.063
T/N	-	-	▲0.001	▲0.061
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.018	▲0.015	▲0.017	▲0.068
2W	▲0.015	▲0.003	▲0.011	▲0.074
3W	-	-	-	▲0.079
1M	-	-	-	▲0.088
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.101
6M	-	-	-	▲0.155
1Y	-	-	-	▲0.179

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

## 本日の市況

本日の無担保コールON物は▲0.020%の出合から始まり、その後は主に▲0.025%~▲0.018%の水準で出合が見られた。同加重平均金利(速報)は前営業日対比▲0.001%の▲0.022%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.040 ~ ▲0.024	▲0.020 ~ ▲0.020	▲0.030 ~ ▲0.015

## 翌営業日のマーケット

引き続きビッドサイドの調達意欲は強く、堅調な地合を予想。

## 資金需給

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	8月5日	8月6日	8月6日	8月7日	8月7日	8月7日
券		+400	▲600	▲1,000		
財政		▲26,600	+1,000	▲3,000		
過不足		▲26,200	+400	▲4,000		
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート
国庫短期証券買入		+20,000				
国債買入				+6,000		
CP等買入	▲200		▲100			
社債等買入					+3,000	
ETF買入		+100		+100		
国債補完供給	+600	▲200	+200			
米ドル資金供給用担保国債供給	▲1,700				+2,400	
当座預金増減		▲7,600	+6,600	+1,400		
当座預金残高		4,470,900	4,477,500	4,478,900		
準備預金残高		3,901,700	主な需給要因			
積み終了先		3,901,600				
超過準備		3,901,600				
非準備先残高		569,200				
準備預金進捗率		99.9%				
平均		67.7%				
乖離率		32.2%				

## 8月5日のオペ結果

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債買入(8/6~)						
3~5年	3,500	12,185	3,507	▲0.005	▲0.005	88.9
10~25年	1,200	3,943	1,211	▲0.009	▲0.008	16.2
変動利付	1,000	1,271	1,002	▲0.290	▲0.292	88.4
社債等買入(8/7~)						
	3,000	7,886	3,000	▲0.044	▲0.034	39.1
国債補完供給(8/5~8/6)						
	177	177	▲0.350	▲0.350		
	0	0				

マナタリーベース [億円]  
8月4日時点 5,666,000

所要 [億円]  
今積期の所要準備額 3,473,200  
8月6日以降の残り所要積数 500  
平均 100

## 国庫短期証券入札予定

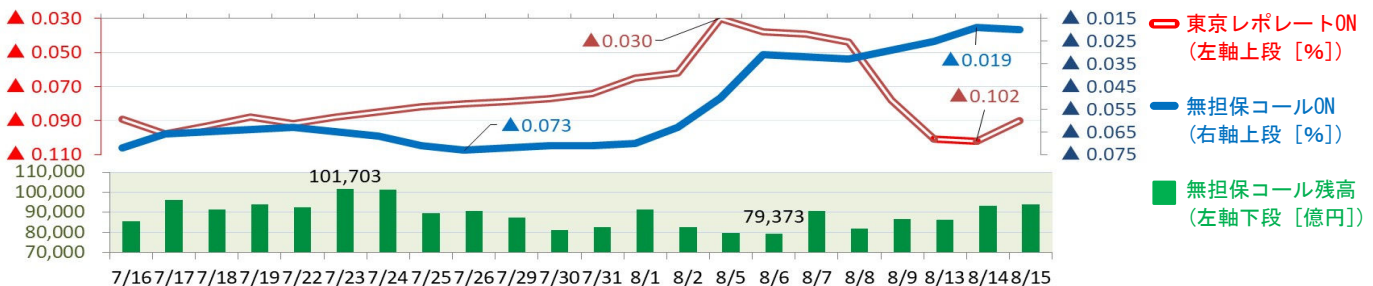
8月6日	6ヶ月	第927回
8月7日	3ヶ月	第928回
8月14日	3ヶ月	
8月19日	1年	
国債入札予定		
8月6日	物価連動	
8月18日	30年	
8月20日	5年	
8月25日	20年	

## 今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオファー金額	直近オファー額	オファー予定日	直近日	残り回数
1年以下	500~1,500	1,000	月3回程度	7月27日	3
1年超3年以下	2,500~6,000	4,200	3 7 13 21 26 31	8月3日	5
3年超5年以下	2,000~5,000	3,500	5 13 19 24 26 31	8月5日	5
5年超10年以下	2,500~6,000	4,200	7 13 19 21 26	7月31日	5
10年超25年以下	500~2,000	1,200	5 28	8月5日	1
25年超	0~500	300	21 28	7月31日	2
物価連動債	300	300	月2回程度	8月3日	1
変動利付債<偶数月>	1,000	1,000	月1回	8月5日	0

## 1年前の市場推移 ○2019年7月積み期 [7月16日~8月15日]

※積み初日及び積み最終日が祝日・休日の場合は、前営業日のレート・残高を記載しています。



本資料は投資環境等に関する情報提供を目的として作成したものです。本資料は投資勧誘を目的とするものではありません。有価証券等の取引には、リスクが伴います。投資についての最終決定は、投資家ご自身の判断と責任においてなされるようお願いいたします。当社は、いかなる投資の妥当性についても保証するものではありません。記載された意見や予測等は作成時点のものであり、正確性、完全性を保証するものではなく、今後予告なく変更されることがあります。